

CORTO PLAZO

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/3CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			559,957,913	33.77%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	342,370,529	20.65%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	207,903,666	12.54%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	9,683,718	0.58%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			922,352,670	55.62%
BI	CETES	250529	AAA(mex)	277,969,020	16.76%
BI	CETES	250430	AAA(mex)	186,706,500	11.26%
BI	CETES	250109	AAA(mex)	96,277,510	5.81%
BI	CETES	250123	AAA(mex)	95,890,120	5.78%
BI	CETES	250821	AAA(mex)	90,505,360	5.46%
BI	CETES	250306	AAA(mex)	47,370,915	2.86%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	43,770,150	2.64%
BI	CETES	260416	AAA(mex)	42,518,155	2.56%
BI	CETES	260806	AAA(mex)	41,344,940	2.49%
	Reportos			175,872,737	10.61%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	175,872,737	10.61%
	TOTAL CARTERA			1,658,183,320	100.00%
	ACTIVO NETO			1,657,754,392	

Cartera al: 30/08/2024

Límite Máximo de VaR: 0.100 % Var Promedio: 0.019 %

Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."